

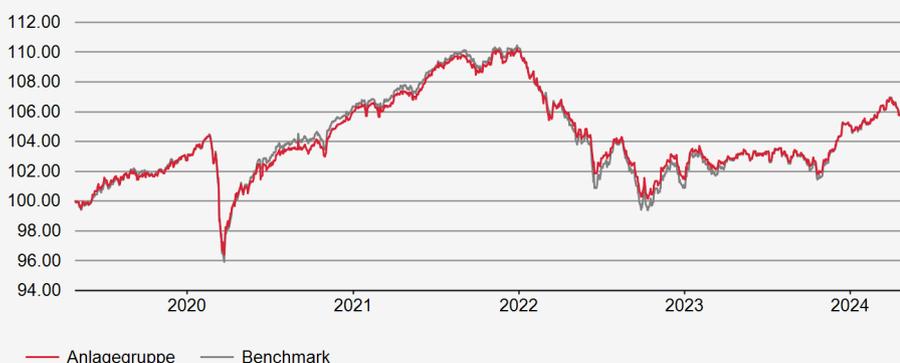
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 227.11**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 170.91**

## Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

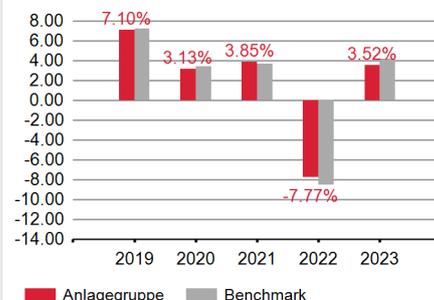
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.96%	-0.77%	0.67%	2.82%	-0.35%	1.19%	2.02%	2.60%
Benchmark	0.91%	-0.83%	0.72%	2.86%	-0.45%	1.18%	2.16%	2.90%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.66	3.61	3.76	3.08	2.84
Volatilität Benchmark (in %)	3.06	4.08	4.10	3.21	2.89
Tracking Error ex post (in %)	0.48	0.66	0.57	0.53	0.58
Information Ratio	-0.08	0.15	0.00	-0.26	-0.50
Sharpe Ratio	0.43	-0.22	0.32	0.77	0.86
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.87	0.88	0.91	0.95	0.97
Jensen-Alpha	0.13	-0.01	0.11	0.00	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-1.68	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	-	-	-

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 1564965

**ISIN:** CH0015649657

**LEI:** 254900RW4KJYAQTH6Y97

**Bloomberg-Code:** SWABM15 SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufgatedatum:** 30/06/2003

**Erstausgabepreis:** 100.00

**Jahresabschluss:** 30.09

**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich

**Annahmeschluss:** 14.00 Uhr

**Ausgabe- / Rücknahmekommission:**  
Keine

**Ausschüttungspraxis:** Thesaurierung

**Asset Manager:**

**Taktische Asset Allocation**

Swiss Life Asset Management AG

**Eingesetzte artreine Anlagegruppen**

Diverse gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®

**Externe Beratung:**

PPCmetrics erbringt innerhalb der artreinen

Anlagegruppen folgende Dienstleistungen:

Beratung betreffend geeigneter

Mandatsstruktur, Unterstützung bei der

Selektion geeigneter Asset Manager sowie

Unterstützung bei der laufenden

Überwachung des Asset Managers und

Beurteilung der Anlageresultate.

**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL

[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.57%

**ex post per:** 30/09/2023 0.59%

**Asset Manager:** Die Auswahl der Manager, deren permanente Überwachung und die gesamte Prozessbegleitung erfolgen nach objektiven Kriterien und bester institutioneller Praxis durch Swiss Life Asset Management AG.

**Betriebsaufwandquote TER KGAST:** Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

**Kommission:** Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a.

**Performance:** Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

**Statistische Angaben:** Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

**Tracking Error ex ante:** Der erwartete Tracking Error für die nächsten 12 Monate entspricht dem ex post 3 Jahres Tracking Error.

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	4.17%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	12.08%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	11.78%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	5.86%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	27.02%	28.00%	-
Aktien Schweiz	7.90%	8.00%	-
Aktien Ausland	7.05%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.30%	-	-
Immobilien Schweiz	18.03%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.53%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.25%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	7.05%	7.00%	30.00%

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.28%
NOVARTIS AG-REG	0.95%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.80%
MICROSOFT CORP.	0.49%
UBS GROUP AG-REG	0.41%
NVIDIA CORP	0.38%
ABB LTD-REG	0.38%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.36%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.34%
ALPHABET INC	0.32%

## Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI Domestic AAA-BBB	13.00%
SBI Foreign AAA-BBB	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	12.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	4.00%
Swiss Performance Index	8.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	5.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	1.05%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.35%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	3.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	90.40%
USD	4.76%
EUR	0.57%
JPY	0.46%
Übrige	3.81%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.38
Durchschnittliches Rating	A+